



UNIVERSITAS SYIAH KUALA

UPT. PERPUSTAKAAN

Jalan T. Nyak Arief, Kampus UNSYIAH, Darussalam – Banda Aceh, Tlp. (0651) 8012380, Kode Pos 23111
Home Page : <http://library.unsyiah.ac.id> Email: helpdesk.lib@unsyiah.ac.id

ELECTRONIC THESIS AND DISSERTATION UNSYIAH

TITLE

ANALISIS PERGERAKAN NILAI TUKAR DI INDONESIA

ABSTRACT

ABSTRAK

Judul : Analisis Pergerakan Nilai Tukar di Indonesia

Nama : Khairita H

NIM : 1201101010032

Fakultas/jurusan : Ekonomi/Ekonomi Pembangunan

Dosen Pembimbing : Fakhruddin, S.E M.S.E

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh antara variabel nilai tukar, jumlah uang beredar (M1), suku bunga deposito, inflasi dan cadangan devisa. Model analisis yang digunakan adalah model Vector Autoregressive (VAR) dengan menggunakan data bulanan dari bulan Juli 2005 sampai bulan Februari 2015. Hasil penelitian menunjukkan bahwa terdapat pengaruh yang signifikan antara nilai tukar terhadap jumlah uang beredar (M1), suku bunga deposito, inflasi, dan cadangan devisa. Ketika satu variabel berubah variabel lain mengikuti pergerakannya dan saling memengaruhi satu sama lain. Untuk penelitian selanjutnya, disarankan untuk menambah jumlah variabel yang akan dikaji guna untuk mengetahui variabel-variabel apa saja yang ikut memengaruhi nilai tukar di Indonesia.

Kata Kunci : Nilai Tukar, M1, Suku Bunga Deposito, Inflasi, cadangan devisa, VAR

ABSTRACT

Title : Analysis on the Exchange Rate Volatility in Indonesia

Student Name : Khairita H

Student ID : 1201101010032

Faculty/ Department : Economics and Business/Economics

Academic Advisor : Fakhruddin, S.E, M.S.E

The purpose of this research is to analyze the impact of money supply (M1), time deposit interest rate, inflation, and foreign exchange reserves to the exchange rate. The Vector Autoregressive (VAR) modelling is employed in the research. Data is monthly data from July 2009 to February 2015. The results of this research show significant impacts between exchange rate, M1, time deposit interest rate, inflation, and foreign exchange reserves. A change in one variabel will lead to changes in other variables. A change in one variable also will affect each other. For the next research, the author suggests to employ different variables to further investigate impacting variables toward exchange rate in Indonesia.

Keywords: Exchange, M1, Interest rate, inflation, foreign reserves, VAR